证券代码:002252 证券简称:上海莱士 公告编号:2018-102

上海莱士血液制品股份有限公司

【2018】第三季度报告

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人陈杰、主管会计工作负责人刘睿及会计机构负责人(会计主管人员)赵曦声明:保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

√ 是 □ 否

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
总资产(元)	11,552,201,383.86	14,455,419,619.02	-20.08%
归属于上市公司股东的净资产(元)	11,119,116,405.18	12,461,758,710.02	-10.77%

	本报告期	本报告期比上年同期增减	年初至报告期末	年初至报告期末比上年同期增减
营业收入(元)	448,272,499.53	-25.32%	1,409,036,172.61	-3.99%
归属于上市公司股东的净利润(元)	-445,689,912.47	-292.68%	-1,292,817,218.64	-237.51%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润(元)	101,392,563.96	-53.57%	408,021,231.03	-16.76%
经营活动产生的现金流量净额(元)	129,534,693.82	-20.64%	218,117,649.54	1.64%
基本每股收益(元/股)	-0.09	-280.00%	-0.26	-236.84%
稀释每股收益(元/股)	-0.09	-280.00%	-0.26	-236.84%
加权平均净资产收益率	-3.93%	减少5.79个百分点	-10.95%	减少18.74个百分点

追溯调整或重述原因

其他原因

	本报告期	上年同期		本报告期比上年同期增减	年初至报告期末	上年同期		年初至报告期末比上年同期增减
		调整前	调整后	调整后		调整前	调整后	调整后
经营活动产生的现金流量净额(元)	129,534,693.82	163,218,480.49	163,218,480.49	-20.64%	218,117,649.54	213,572,594.54	214,598,594.54	1.64%

其他原因追溯调整的情况

财政部发布《关于2018年度一般企业财务报表格式有关问题的解读》中规定:企业实际收到的政府补助,无论是与资产相关还是与收益相关,在编制现金流量表时,均作为经营活动产生的现金流量列报。根据《企业会计准则第30号——财务报表列报》的相关规定,当期财务报表的列报,至少应当提供上一个可比会计期间的比较数据。企业按照相关规定追溯应用会计政策或发生前期差错更正,并采用追溯调整法的,应当对可比会计期间的比较数据进行相应调整。上年同期公司实际收到与资产相关的政府补助1,026,000.00元,在编制现金流量表时作为投资活动产生的现金流量列报,计入“收到的其他与投资活动有现的现金流量”,本期进行追溯调整,计入“收到的其他与经营活动有关的现金流量”。

非经常性损益项目和金额

√ 适用 □ 不适用

单位:元

项目	年初至报告期期末金额	说明
非流动资产处置损益(包括已计提资产减值准备的冲销部分)	1,463.57	
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	22,807,120.60	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益	-2,006,702,091.71	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-1,206,896.38	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	-15,279,100.41	
减:所得税影响额	-299,651,811.30	
少数股东权益影响额(税后)	110,756.64	
合计	-1,700,838,449.67	--

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目,以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目,应说明原因

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在将根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义、列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东和表决权恢复的优先股股东数量及前10名股东持股情况表

单位:股

报告期末普通股股东总数	27,547	报告期末表决权恢复的优先股股东总数	0

前10名股东持股情况					
股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押或冻结情况 股份状态	数量
科瑞天诚投资控股有限公司	境内非国有法人	32.07%	1,595,529,564	0	质押	1,510,529,252
RAAS CHINA LIMITED	境外法人	30.34%	1,509,120,000	0	质押	1,460,618,800
宁波科瑞金鼎投资合伙企业(有限合伙)	境内非国有法人	4.59%	228,119,166	0	质押	227,635,898
深圳莱士凯吉投资咨询有限公司	境内非国有法人	4.59%	228,119,166	0	质押	226,000,000
新疆华建恒业股权投资有限公司	境内非国有法人	3.18%	158,281,392	0	质押	98,916,600
鹏华资产-平安银行-鹏华资产凯吉莱士1期资产管理计划	其他	1.35%	67,001,247	0	-	-
鹏华资产-平安银行-鹏华资产科瑞莱士资产管理计划	其他	1.31%	64,985,895	0	-	-
陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·鑫鑫向荣82号证券投资集合资金信托计划	其他	0.93%	46,393,027	0	-	-
民生通惠资产-民生银行-民生通惠聚鑫2号资产管理产品	其他	0.91%	45,256,840	0	-	-
陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·鑫鑫向荣76号证券投资集合资金信托计划	其他	0.91%	45,114,016	0	-	-

前10名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类 股份种类	数量
科瑞天诚投资控股有限公司	1,595,529,564	人民币普通股	1,595,529,564
RAAS CHINA LIMITED	1,509,120,000	人民币普通股	1,509,120,000
宁波科瑞金鼎投资合伙企业(有限合伙)	228,119,166	人民币普通股	228,119,166
深圳莱士凯吉投资咨询有限公司	228,119,166	人民币普通股	228,119,166
新疆华建恒业股权投资有限公司	158,281,392	人民币普通股	158,281,392
鹏华资产-平安银行-鹏华资产凯吉莱士1期资产管理计划	67,001,247	人民币普通股	67,001,247
鹏华资产-平安银行-鹏华资产科瑞莱士资产管理计划	64,985,895	人民币普通股	64,985,895
陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·鑫鑫向荣82号证券投资集合资金信托计划	46,393,027	人民币普通股	46,393,027
民生通惠资产-民生银行-民生通惠聚鑫2号资产管理产品	45,256,840	人民币普通股	45,256,840
陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·鑫鑫向荣76号证券投资集合资金信托计划	45,114,016	人民币普通股	45,114,016

上述股东关联关系或一致行动的说明	1、公司前10名股东中,科瑞天诚投资控股有限公司(“科瑞天诚”)和RAAS CHINA LIMITED(莱士中国有限公司,“莱士中国”)为公司控股股东;科瑞天诚担任宁波科瑞金鼎投资合伙企业(有限合伙)(“科瑞金鼎”)普通合伙人;深圳莱士凯吉投资咨询有限公司(“深圳莱士”)为莱士中国的全资子公司;鹏华资产-平安银行-鹏华资产科瑞莱士资产管理计划(“鹏华科瑞资管”)为科瑞天诚通过鹏华资产管理(深圳)有限公司(“鹏华资产”)发起设立的资产管理计划;鹏华资产-平安银行-鹏华资产凯吉莱士1期资产管理计划(“鹏华凯吉资管”)为莱士中国全资子公司上海凯吉通过鹏华资产发起设立的资产管理计划。除前述关联关系外,公司控股股东与其他前10名股东之间不存在关联关系,也不属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。 2、公司未知除控股股东及其关联方(科瑞金鼎、深圳莱士、鹏华科瑞资管、鹏华凯吉资管)外的其它前10名股东之间是否存在关联关系,也未知其他前10名股东之间是否属于《上市公司收购管理办法》中规定的一致行动人。

前10名普通股股东参与融资融券业务情况说明	截至2018年9月30日,公司前10名股东中,科瑞天诚通过客户信用交易担保证券账户持有公司15,000,000股股份,通过普通证券账户持有本公司1,580,529,564股股份,合计持有本公司1,595,529,564股股份。

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

□ 是 √ 否

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

2、公司优先股股东总数及前10名优先股股东持股情况表

□ 适用 √ 不适用

第三节重要事项

一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

项目	期末(年初到报告期末)金额	期初(上年同期)金额	变动比例	变动原因
货币资金	867,642,126.74	1,385,834,237.38	-37.39%	主要变动原因是本期偿还“12莱士债”3.6亿元。
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	300,042,000.00	3,136,360,661.90	-90.43%	主要变动原因是本期处置了交易性金融资产,以及持有的交易性金融资产价格波动,其公允价值减少。
应收票据	57,644,148.33	158,597,441.78	-63.65%	主要变动原因是期初票据本期兑付。
预付款项	29,150,056.36	19,186,924.02	51.93%	主要变动原因是预付采购较期初增加。
存货	1,520,860,874.28	1,154,545,842.24	31.73%	主要变动原因是库存商品及在产品库存较期初增加。
其他流动资产	2,207,082.43	10,443,828.04	-78.87%	主要变动原因是本期集合资金信托计划终止清算,处置相应信托业保障基金。
可供出售金融资产	3,268,065.01	268,065.01	1119.13%	变动原因是本期投资创吉八号300万元。
在建工程	62,506,995.59	37,621,580.77	66.15%	主要变动原因是下属聚站建设工程本期投入所致。
递延所得税资产	190,407,390.59	31,194,002.91	510.40%	主要变动原因是本期交易性金融资产的投资亏损及公允价值变动产生的递延所得税资产所致。
其他非流动资产	54,978,655.89	23,537,012.10	133.58%	主要变动原因是本期长期资产采购增加。
应付职工薪酬	34,121,958.80	62,862,683.01	-45.72%	主要变动原因是本期支付前期计提应付职工薪酬。
应交税费	16,659,886.92	82,953,580.23	-79.92%	主要变动原因是本期缴纳前期计提企业所得税。
其他应付款	69,110,762.50	109,345,132.79	-36.80%	主要变动原因是本期支付了代和代缴股权激励股金和“12莱士债”应付利息。
一年内到期的非流动负债	-	360,000,000.00	-100.00%	一年内到期的非流动负债减少是由于本期偿还“12莱士债”。
递延所得税负债	16,502,230.79	145,733,153.09	-88.68%	主要变动原因是本期交易性金融资产公允价值变动减少相应的递延所得税负债。
其他非流动负债	-	1,096,000,000.00	-100.00%	变动原因是报告期内偿还集合资金信托计划优先级份额。
销售费用	112,054,791.51	26,741,554.49	319.03%	主要变动原因是本期公司从以往商业渠道市场销售模式向医院终端市场模式的转型,故销售费用较上年同期增加。
管理费用	231,930,474.03	177,550,376.06	30.63%	主要变动原因是本期大修停工损失、修理费和重大资产重组相关中介费用较上年同期增加。
财务费用	39,900,621.93	23,056,455.22	73.06%	主要变动原因是本期支付给资产管理计划和资金信托计划的优先级份额的固定收益金额较上年同期增加,以及银行存款利息收入较上年同期减少。
资产减值损失	6,080,392.79	46,685,988.64	-86.98%	主要变动原因是上年同期应收账款大额增加,故计提的坏账准备较多。
公允价值变动收益	-896,536,110.71	117,247,590.44	-864.65%	主要变动原因是处置交易性金融资产,转回以前年度确认的公允价值变动收益,以及持有的交易性金融资产价格波动,产生账面投资浮亏。
投资收益	-1,125,445,081.41	394,007,459.08	-385.64%	主要变动原因是本期交易性金融资产持有期间和处置时产生的投资收益,以及对同方莱士投资比例穿有的净资产增加或减少额。
投资活动产生的现金流量净额	724,363,161.59	-834,726,624.66	186.78%	主要变动原因是本期投资活动流入同比减少2.55亿元,本期投资活动流出现金同比减少18.14亿元,故投资活动产生的现金流出净额较上年同期大幅减少。
筹资活动产生的现金流量净额	-1,462,787,830.20	176,515,655.37	-928.70%	主要变动原因是本期偿还“12莱士债”3.6亿元和集合资金信托计划优先级份额10.96亿元。

二、重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√ 适用 □ 不适用

1、风险投资事项

(1)证券投资审议批准情况

2015年1月5日,公司召开第三届董事会第二十二次(临时)会议,审议通过了《公司关于进行风险投资事项的议案》,同意公司在充分保障公司日常经营性资金需求,不影响公司正常生产经营开有效控制风险的前提下,拟使用自有资金最高不超过(含)人民币10.00亿元用于风险投资,使用期限为2年,该额度可以在2年内循环使用。该事项于2015年1月20日经公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

2016年2月4日及2016年2月22日,公司分别召开了第三届董事会第三十一次(临时)会议及2016年第一次临时股东大会,审议通过了《关于公司上调风险投资额度及投资期限的议案》,同意公司为进一步提升资金使用效率、资金收益水平、增强公司盈利能力,将投资最高额度由原最高不超过(含)10.00亿元调整为不超过(含)40.00亿元;使用期限由原2年调整为自2016年2月22日起3年。

(2)证券投资情况

1)万丰奥威

基于公司及董事会战略委员会对浙江万丰奥威汽轮股份有限公司(“万丰奥威”,证券代码:002085)进行的研究分析和论证,2015年1月22日,公司通过深圳证券交易所大宗交易系统购入万丰奥威股票1,900万股,均价为26.10元/股,其计使用自有资金人民币49,590.00万元。

2015年8月31日,万丰奥威实施了2015年上半年度权益分派:以资本公积向全体股东每10股转增12股,除权后公司共计持有万丰奥威股票4,180万股。

2016年2月23日、25日、26日、29日、3月1日,公司通过二级市场合计购入万丰奥威股票2,325,214股,均价为27.97元/股,共计使用自有资金人民币65,045,038.99元。截至2016年3月1日合计持有万丰奥威股票44,125,214股。

2016年5月4日,万丰奥威实施了2015年度权益分派:向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利0.50元(含税)、送红股2股(含税),以资本公积金向全体股东每10股转增8股,除权后公司共计持有万丰奥威股票88,250,428股。

2016年10月25日及10月26日,公司通过深交所大宗交易系统分别卖出万丰奥威3,000万股(均价为21.60元/股)、1,700万股(均价为21.39元/股),截至2016年10月26日合计持有万丰奥威股票41,250,428股,实现投资收益66,839.28万元。

2017年5月22日,万丰奥威实施了2016年度权益分派:向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利1.00元(含税)、送红股2股(含税),不以公积金转增股本,除权后公司共计持有万丰奥威股票49,500,513股。

2017年6月13日、14日、15日、16日、19日、20日、21日及22日,公司通过二级市场合计购入万丰奥威股票20,058,971股,均价为15.95元/股,其计使用自有资金人民币31,991.47万元。截至2017年6月22日合计持有万丰奥威股票69,559,484股。

2017年5月22日,万丰奥威实施了2017年度权益分派:向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利3.00元(含税)。

2018年8月14日、8月22日、8月23日、8月24日、8月27日、8月28日、8月29日及8月30日,公司通过二级市场合计卖出万丰奥威股票27,359,484股,均价7.26元/股。

截至2018年9月30日,公司共持有万丰奥威42,200,000股,累计实现公允价值变动收益-5,311.22万元,累计实现投资收益66,469.54万元(其中,2018年1月1日至9月30日实现公允价值变动收益-71,611.27万元,实现投资收益-976.44万元)。

2)天治星辰5号

2016年4月6日,公司召开了第四届董事会第一次会议,审议通过了《关于使用自有闲置资金参与资产管理计划事项的议案》,同意公司使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购申购型资产管理计划普通级份额。公司于2016年4月7日,使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购由天治基金管理有限公司设立的天治星辰5号普通级份额,优先级份额和普通级份额认购比例为1:1,本次资管计划资产规模为人民币6.00亿元。该资管计划是通过对沪深二级市场股票、固定收益类产品等的积极投资,在控制风险的前提下,谋求最大限度地资产增值。

天治星辰5号于2016年4月11日,通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司(“兴源环境”,股票代码:300266)股票1,500万股,均价为34.38元/股,交易总金额为人民币51,570.00万元。

2016年6月1日,兴源环境实施了2015年度权益分派:向全体股东每10股派0.20元人民币现金(含税),同时以资本公积金向全体股东每10股转增1股,除权后公司共计持有兴源环境股票1,650万股。

2016年6-9月,公司通过二级市场累计购入兴源环境1,502,754股,均价为40.29元/股,交易总金额为人民币6,055.35万元。截至2016年9月底合计持有兴源环境股票18,002,754股。

天治星辰5号约定的存续期间为12个月,已于2017年4月到期。按照约定,由于天治星辰5号到期时,所购买的兴源环境股票处于停牌状态,待兴源环境股票复牌后第一个工作日执行卖出。

2017年5月18日,兴源环境股票复牌,天治星辰5号通过深交所大宗交易系统卖出兴源环境股票18,002,754股,均价为47.60元/股;2018年8月,公司收到天治星辰5号资产管理计划二次清算款7,49万元。截至2018年9月30日,天治星辰5号已清算完毕,累计实现投资收益28,066.48万元。

3)金鸡报晓3号

2017年3月21日,公司召开了第四届董事会第十四次(临时)会议,审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》,同意公司使用3.33亿元自有闲置资金参与认购集合资金信托计划劣后级份额。公司于2017年3月22日,使用3.33亿元自有闲置资金参与认购厦门国际信托有限公司根据信托合同设立的金鸡报晓3号劣后级份额,优先级信托资金:劣后级信托资金为2:1,本次信托计划规模为人民币9.99亿元。该信托计划使用9.99亿元对云南信托设立的云南信托聚利43号单一资金信托(“聚利43号”)进行投资。该单一信托按照其信托合同的约定专项投资于①股票;②债券;③基金;④货币市场工具及银行存款;⑤信托业保障基金。

上述信托计划期限为24个月,自信托计划成立之日起计算。该期限为本信托计划的预计存续期限,如在该期限内出现合同规定的终止情形,则本信托计划将提前终止;如果该期限届满时信托计划存在非货币形态的信托财产,则信托计划期限自动延长至信托计划项下信托财产全部变现且变现所得全部进入信托专户之日。

上述信托计划存续期间受托人以货币形态的信托财产和除此由信托财产承担的税费、信托费用和对第三人负债后的剩余部分为限向优先级受益人分配信托收益,受益人可获得分配的信托收益的实际金额根据合同规定的计算方法确定。信托计划存续期间,不向劣后级受益人分配信托利益;信托计划终止后,在优先级受益人的信托资金本金得到足额返还且其预期信托收益得到足额分配时,根据合同的约定分派顺序以剩余信托财产为限向劣后级受益人分配信托利益。

上述信托计划终止时且全部信托计划完成清算时(包括提前终止)获取的财产及收益不足以覆盖优先级委托人的资金本金、按照合同预定的预期年化收益率计算的收益及各项费用,则差额义务补足人应向优先级委托人履行差额付款补足义务,差额付款人其所承担的差额付款义务至信托计划清算完毕为止。按照合同约定履行差额补足义务并承担无限连带责任。

聚利43号于2017年5月18日,通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司(“兴源环境”,股票代码:300266)股票18,002,754股,均价为47.60元/股,交易总金额为856,931,090.40元。

聚利43号于2017年6月5日、6日、7日、8日及12日,通过二级市场合计购入兴源环境股票897,226股,均价为49.81元/股,其计使用信托资金人民币4,469.07万元。截至2017年6月12日合计持有兴源环境股票18,899,980股。

2017年6月20日,兴源环境实施了2016年度权益分派:向全体股东以资本公积向全体股东每10股转增10股,以未分配利润每10股派发现金红利0.50元(含税),除权后聚利43号共计持有兴源环境股票37,799,960股。

2018年2月2日,金鸡报晓3号财产净值跌破止损线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年2月5日追加补仓资金8,635.00万元;因每日计提各项费用,所持有兴源环境股票仍处于停牌等因素,公司分别于2月7日、3月8日、4月4日、4月19日、5月4日及6月5日分别追加了补仓资金400.00万元、360.00万元、200.00万元、200.00万元、400.00万元及400.00万元。

2018年7月2日,兴源环境复牌,金鸡报晓3号财产净值低于止损线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年7月3日追加补仓资金7,457.00万元。

2018年7月4日,金鸡报晓3号财产净值低于止损线,按合同约定需追加补仓资金,鉴于当时二级市场波动剧烈,二级市场走势存在较大不确定性,公司决定暂缓追加信托资金,公司持有的金鸡报晓3号认购的聚利43号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现,直至信托计划资产全部变现为止。金鸡报晓3号财产净值低于止损线后,公司仍与信托计划优先级受益人、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通,寻求合理的方式或途径降低公司的损失,维护公司的利益。公司作为金鸡报晓3号信托计划差额义务补足人需为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付履行差额补足义务。

截至2018年7月13日,金鸡报晓3号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现,公司作为金鸡报晓3号差额义务补足人于2018年7月13日支付15,820.56万元,为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付部分履行了差额补足义务。金鸡报晓3号于2018年7月13日提前终止。

根据信托利益分配报告,金鸡报晓3号累计实现投资收益约为-60,673.40万元(其中2017年实现投资收益102.28万元,2018年实现投资收益-60,775.68万元)。根据企业会计准则及其他相关规定,2018年处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益-11,897.72万元。金鸡报晓3号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-22,732.33万元。

4)持盈78号

2017年11月20日,公司以通讯方式召开了第四届董事会第二十二次(临时)会议,审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》,同意公司分别使用250亿元及180亿元自有闲置资金参与认购陕国投·持盈78号证券投资集合资金信托计划及陕国投·持盈79号证券投资集合资金信托计划劣后级份额。

2017年11月20日,公司使用1.80亿元自有闲置资金参与认购持盈79号部分份额,持盈79号信托计划规模总额为人民币3.60亿元,上海莱士认购其中的1.80亿元。

2017年11月23日,持盈79号通过深交所大宗交易系统购入兴源环境股票1,258万股,均价为25.80元/股,交易总金额为32,456.40万元。

2018年2月2日,持盈79号财产净值跌破止损线,按照合同约定,公司需追加补仓资金,公司于2018年2月5日追加补仓资金2,380.00万元。

2018年7月2日,兴源环境复牌,持盈79号按照合同约定于停牌期间采用持有标的所属行业指数计算的财产净值低于追加线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年7月2日追加补仓资金3,710.00万元。

2018年7月3日,持盈79号财产净值跌破止损线,按照合同约定,公司需追加补仓资金,公司于2018年7月3日追加补仓资金230.00万元。

截至7月5日,持盈79号财产净值跌破平仓线,按合同约定,公司需追加补仓资金,鉴于当时二级市场波动剧烈,二级市场走势存在较大不确定性,公司决定暂缓追加信托资金,持盈79号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现,直至信托计划资产全部变现为止。持盈79号财产净值低于平仓线后,公司仍与信托计划委托人A、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通,寻求合理的方式或途径降低公司的损失,维护公司的利益。公司作为持盈79号优先级受益人还需为持盈79号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付履行差额补足义务。

截至2018年7月13日,持盈79号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现,公司作为持盈79号差额义务补足人于2018年7月13日支付15,820.56万元,为持盈79号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付部分履行了差额补足义务。持盈79号于2018年7月13日提前终止。

根据信托利益分配报告,持盈79号累计实现投资收益约为-60,673.40万元(其中2017年实现投资收益102.28万元,2018年实现投资收益-60,775.68万元)。根据企业会计准则及其他相关规定,2018年处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益-11,897.72万元。金鸡报晓3号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-22,732.33万元。

5)持盈79号

2017年11月20日,公司召开了第四届董事会第二十二次(临时)会议,审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》,同意公司分别使用250亿元及180亿元自有闲置资金参与认购陕国投·持盈78号证券投资集合资金信托计划及陕国投·持盈79号证券投资集合资金信托计划劣后级份额。

2017年11月20日,公司使用1.80亿元自有闲置资金参与认购持盈79号部分份额,持盈79号信托计划规模总额为人民币3.60亿元,上海莱士认购其中的1.80亿元。

2017年11月23日,持盈79号通过深交所大宗交易系统购入兴源环境股票1,258万股,均价为25.80元/股,交易总金额为32,456.40万元。

2018年2月2日,持盈79号财产净值跌破止损线,按照合同约定,公司需追加补仓资金,公司于2018年2月5日追加补仓资金2,380.00万元。

2018年7月2日,兴源环境复牌,持盈79号按照合同约定于停牌期间采用持有标的所属行业指数计算的财产净值低于追加线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年7月2日追加补仓资金3,710.00万元。

2018年7月3日,持盈79号财产净值跌破止损线,按照合同约定,公司需追加补仓资金,公司于2018年7月3日追加补仓资金230.00万元。

截至7月5日,持盈79号财产净值跌破平仓线,按合同约定,公司需追加补仓资金,鉴于当时二级市场波动剧烈,二级市场走势存在较大不确定性,公司决定暂缓追加信托资金,持盈79号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现,直至信托计划资产全部变现为止。持盈79号财产净值低于平仓线后,公司仍与信托计划委托人A、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通,寻求合理的方式或途径降低公司的损失,维护公司的利益。公司作为持盈79号优先级受益人还需为持盈79号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付履行差额补足义务。

截至2018年7月13日,持盈79号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现,公司作为持盈79号差额义务补足人于2018年7月13日支付15,820.56万元,为持盈79号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付部分履行了差额补足义务。持盈79号于2018年7月13日提前终止。

根据信托利益分配报告,持盈79号累计实现投资收益约为-60,673.40万元(其中2017年实现投资收益102.28万元,2018年实现投资收益-60,775.68万元)。根据企业会计准则及其他相关规定,2018年处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益-11,897.72万元。金鸡报晓3号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-22,732.33万元。

6)天治星辰5号

2016年4月6日,公司召开了第四届董事会第一次会议,审议通过了《关于使用自有闲置资金参与资产管理计划事项的议案》,同意公司使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购股票型资产管理计划普通级份额。公司于2016年4月7日,使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购由天治基金管理有限公司设立的天治星辰5号普通级份额,优先级份额和普通级份额认购比例为1:1,本次资管计划资产规模为人民币6.00亿元。该资管计划是通过对沪深二级市场股票、固定收益类产品等的积极投资,在控制风险的前提下,谋求最大限度地资产增值。

天治星辰5号于2016年4月11日,通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司(“兴源环境”,股票代码:300266)股票1,500万股,均价为34.38元/股,交易总金额为人民币51,570.00万元。

2016年6月1日,兴源环境实施了2015年度权益分派:向全体股东每10股派0.20元人民币现金(含税),同时以资本公积金向全体股东每10股转增1股,除权后公司共计持有兴源环境股票1,650万股。

2016年6-9月,公司通过二级市场累计购入兴源环境1,502,754股,均价为40.29元/股,交易总金额为人民币6,055.35万元。截至2016年9月底合计持有兴源环境股票18,002,754股。

天治星辰5号约定的存续期间为12个月,已于2017年4月到期。按照约定,由于天治星辰5号到期时,所购买的兴源环境股票处于停牌状态,待兴源环境股票复牌后第一个工作日执行卖出。

2017年5月18日,兴源环境股票复牌,天治星辰5号通过深交所大宗交易系统卖出兴源环境18,002,754股,均价为47.60元/股;2018年8月,公司收到天治星辰5号资产管理计划二次清算款7,49万元。截至2018年9月30日,天治星辰5号已清算完毕,累计实现投资收益28,066.48万元。

3、金鸡报晓3号

2017年3月21日,公司召开了第四届董事会第十四次(临时)会议,审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》,同意公司使用3.33亿元自有闲置资金参与认购集合资金信托计划劣后级份额。公司于2017年3月22日,使用3.33亿元自有闲置资金参与认购厦门国际信托有限公司根据信托合同设立的金鸡报晓3号劣后级份额,优先级信托资金:劣后级信托资金为2:1,本次信托计划规模为人民币9.99亿元对云南信托设立的云南信托聚利43号单一资金信托(“聚利43号”)进行投资。该单一信托按照其信托合同的约定专项投资于①股票;②债券;③基金;④货币市场工具及银行存款;⑤信托业保障基金。

上述信托计划期限为24个月,自信托计划成立之日起计算。该期限为本信托计划的预计存续期限,如在该期限内出现合同规定的终止情形,则本信托计划将提前终止;如果该期限届满时信托计划存在非货币形态的信托财产,则信托计划期限自动延长至信托计划项下信托财产全部变现且变现所得全部进入信托专户之日。

上述信托计划存续期间受托人以货币形态的信托财产和除此由信托财产承担的税费、信托费用和对第三人负债后的剩余部分为限向优先级受益人分配信托收益,受益人可获得分配的信托收益的实际金额根据合同规定的计算方法确定。信托计划存续期间,不向劣后级受益人分配信托利益;信托计划终止后,在优先级受益人的信托资金本金得到足额返还且其预期信托收益得到足额分配时,根据合同的约定分派顺序以剩余信托财产为限向劣后级受益人分配信托利益。

上述信托计划终止时且全部信托计划完成清算时(包括提前终止)获取的财产及收益不足以覆盖优先级委托人的资金本金、按照合同预定的预期年化收益率计算的收益及各项费用,则差额义务补足人应向优先级委托人履行差额付款补足义务,差额付款人其所承担的差额付款义务至信托计划清算完毕为止。按照合同约定履行差额补足义务并承担无限连带责任。

聚利43号于2017年5月18日,通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司(“兴源环境”,股票代码:300266)股票18,002,754股,均价为47.60元/股,交易总金额为856,931,090.40元。

聚利43号于2017年6月5日、6日、7日、8日及12日,通过二级市场合计购入兴源环境股票897,226股,均价为49.81元/股,其计使用信托资金人民币4,469.07万元。截至2017年6月12日合计持有兴源环境股票18,899,980股。

2017年6月20日,兴源环境实施了2016年度权益分派:向全体股东以资本公积向全体股东每10股转增10股,以未分配利润每10股派发现金红利0.50元(含税),除权后聚利43号共计持有兴源环境股票37,799,960股。

2018年2月2日,金鸡报晓3号财产净值跌破止损线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年2月5日追加补仓资金8,635.00万元;因每日计提各项费用,所持有兴源环境股票仍处于停牌等因素,公司分别于2月7日、3月8日、4月4日、4月19日、5月4日及6月5日分别追加了补仓资金400.00万元、360.00万元、200.00万元、200.00万元、400.00万元及400.00万元。

2018年7月2日,兴源环境复牌,金鸡报晓3号财产净值低于止损线,按合同约定需追加补仓资金,公司于2018年7月3日追加补仓资金7,457.00万元。

2018年7月4日,金鸡报晓3号财产净值低于止损线,按合同约定需追加补仓资金,鉴于当时二级市场波动剧烈,二级市场走势存在较大不确定性,公司决定暂缓追加信托资金,公司持有的金鸡报晓3号认购的聚利43号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现,直至信托计划资产全部变现为止。金鸡报晓3号财产净值低于止损线后,公司仍与信托计划优先级受益人、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通,寻求合理的方式或途径降低公司的损失,维护公司的利益。公司作为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付履行差额补足义务。

截至2018年7月13日,金鸡报晓3号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现,公司作为金鸡报晓3号差额义务补足人于2018年7月13日支付15,820.56万元,为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付部分履行了差额补足义务。金鸡报晓3号于2018年7月13日提前终止。

根据信托利益分配报告,金鸡报晓3号累计实现投资收益约为-60,673.40万元(其中2017年实现投资收益102.28万元,2018年实现投资收益-60,775.68万元)。根据企业会计准则及其他相关规定,2018年处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年转回以前年度已确认的公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益,故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益-11,897.72万元。金鸡报晓3号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-22,732.33万元。

7)持盈78号

2017年11月20日,公司以通讯方式召开了第四届董事会第二十二次(临时)会议,审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》,同意公司分别使用250亿元及180亿元自有闲置资金参与认购陕国投·持盈78号证券投资集合资